

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）2023 年一季度投资管理报告

报告日：2023 年 03 月 31 日

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）于 2022 年 05 月 06 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 714,354,533.92 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2023 年 03 月 31 日，产品单位净值为 1.020076。本报告期内，产品存续规模如下：

日期	份额净值	累计净值	资产净值
报告日 (报告期末最后一个市场交易日)	1.020076	1.026576	714,354,533.92
一个月前	1.016994	1.020994	712,297,713.63
二个月前	1.013832	1.015832	710,083,477.72
三个月前	1.003940	1.004940	703,154,961.76
六个月前	1.012025	1.012025	708,817,251.91
一年前	-	-	-

超额业绩报酬暂估测算：报告日预测超额业绩报酬暂估计提金额 0 元，计提后单位净值 1.020076。

相关收益及计算方法，请具体查阅对应的收益率调整公告及产品说明书。

二、产品投资组合详细情况

产品名称	募集起始日	募集结束日	产品成立日	产品到期日
建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）	2022-04-25	2022-05-05	2022-05-06	2025-05-06

理财产品管理人：建信理财有限责任公司

理财产品托管人：中国建设银行股份有限公司深圳市分行

三、期末资产持仓穿透后穿透前

资产类别	穿透前金额 (万元)	占全部产品总资产 的比例 (%)	穿透后金额 (万元)	占全部产品总资产 的比例 (%)
现金及银行存款	143.80	0.20%	2,829.87	3.35%
同业存单	0.00	0.00%	3,848.57	4.55%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	600.44	0.71%
债券	0.00	0.00%	59,257.35	70.11%
理财直接融资工具	0.00	0.00%	0.00	0.00%
新增可投资资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%
非标准化债权类资产	10,983.45	15.44%	10,983.45	12.99%
权益类投资	0.00	0.00%	4,527.51	5.36%
金融衍生品	0.00	0.00%	-1.83	0.00%
代客境外理财投资 QDII	0.00	0.00%	0.00	0.00%
商品类资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%
另类资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%
公募基金	0.00	0.00%	2,479.86	2.93%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	60,020.94	84.36%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	71,148.18	100.00%	84,525.23	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.02%

注：杠杆比例=期末穿透前资产合计/期末资产净值。

四、前十大投资资产明细

序号	资产名称	资产规模 (元)	资产占比 (%)
1	22 前海华宝 AB017	109,834,457.36	12.82%
2	22 中国银行永续债 02	24,424,100.33	2.85%

3	22 中国银行永续债 01	18,352,173.89	2.14%
4	21 招商银行永续债	17,131,255.28	2.00%
5	23 中信银行 CD054	13,096,005.88	1.53%
6	23 广发银行 CD075	13,096,005.88	1.53%
7	22 农业银行永续债 01	12,177,954.33	1.42%
8	21 建设银行二级 03	9,595,152.57	1.12%
9	21 青城 11	7,552,385.87	0.88%
10	21 农业银行永续债 01	7,397,726.91	0.86%

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十项资产

五、风险分析

（一）产品的流动性风险情况

本产品为封闭式产品，主要投资于标准化资产，资产流动性较好。

（二）市场情况

本产品采用固收增强投资策略，在获取稳健收益的同时，分散单一资产下跌风险。其中固收类资产投资占比不低于 80%，其他非固收类资产投资占比不超过 20%。

回顾一季度，固收方面，春节前受基本面压制走弱；春节后超预期降准及海外银行体系风险事件，推动债市走强。权益方面，经济复苏背景下，春季前表现较好，春节后市场走势分化，结构性行情为主。

展望未来，经济基本面复苏，流动性依然维持宽松预期，预期权益市场机会增加。

六、托管人报告

在本报告期间，托管人对管理人的投资运作行为进行了监督，未发现存在损害本产品利益的行为。

在本报告期间，托管人以诚实信用、勤勉尽责的原则认真办理理财资金托管事项，履行托管人职责。

七、投资账户信息

序号	账户类型	账户编号	账户名称	开户单位
1	托管户	4425010000040003919	建信理财有限责任公司 理财产品托管专户	中国建设银行股份有限公司深圳市分行

八、报告期内关联交易情况

（一）理财产品投资与本公司或托管机构有重大利害关系的机构发行或承销的证券

序号	证券简称	证券类别	证券代码	数量	净价	关联方名称	关联方角色
1	22 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	177,135	100.4858	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	121,847	99.9615	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	45,625	101.5918	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	40,258	100.3616	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	21 川能投 MTN002A	企业债务融资工具	102101520. IB	28,919	100.2123	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
6	21 渝高建投 MTN001	企业债务融资工具	102102220. IB	16,103	100.1898	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	22 农行永续债 02	商业性金融债券	092280086. IB	34,890	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
8	22 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102280164. IB	8,051	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
9	22 昆山国创 MTN007	企业债务融资工具	102282049. IB	26,838	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

						公司	
10	22 浙银租赁货运物流主题债	商业性金融债券	2222004. IB	2,683	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
11	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	13,419	100.1892	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	22 云天化 MTN001	企业债务融资工具	102281519. IB	26,838	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
13	22 曲文投 MTN001	企业债务融资工具	102281604. IB	34,890	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
14	22 淮北建投 MTN003	企业债务融资工具	102281419. IB	8,051	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
15	22 晋能煤业 MTN013(科创票据)	企业债务融资工具	102281337. IB	29,522	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
16	22 新庐陵 MTN001	企业债务融资工具	102281265. IB	37,574	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
17	22 合肥产投 MTN001(科创票据)	企业债务融资工具	102281241. IB	45,625	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	21 苏海投资 MTN001	企业债务融资工具	102103327. IB	13,419	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	22 昆钢 MTN001	企业债务融资工具	102280779. IB	64,413	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
20	22 五凌 1 号 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280989. IB	8,051	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	22 中建投资 MTN001(绿色)	企业债务融资工具	102280709. IB	2,147	100.4816	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
22	22 贵州交通 MTN002	企业债务融资工具	102200161. IB	26,838	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
23	22 渝兴永 MTN001	企业债务融资工具	102280163. IB	4,025	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	21 长安汇	企业债务	032191358. IB	8,051	100.0000	中国建设银	主承销商或

	通 PPN001	融资工具				行股份有限 公司	联席承销商
25	21 淄博城 运 MTN003	企业债务 融资工具	102103220. IB	2,683	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
26	21 淮安国 投 MTN003	企业债务 融资工具	102103248. IB	8,051	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
27	22 珠海华 发 ABN001 优先	资产支持 证券	082282014. IB	7,783	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
28	21 临沂投 资 MTN003	企业债务 融资工具	102102176. IB	13,419	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
29	22 象屿 MTN001 (科 创票据)	企业债务 融资工具	102281255. IB	53,677	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
30	22 北部湾 MTN001	企业债务 融资工具	102280032. IB	18,787	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
31	21 益阳城 投 MTN001	企业债务 融资工具	102102158. IB	13,419	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
32	19 工商银 行永续债	商业性金 融债券	1928018. IB	2,683	101.6740	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
33	22 昆交产 SCP002	企业债务 融资工具	012283632. IB	13,419	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
34	21 靖江港 口 PPN001	企业债务 融资工具	032191490. IB	16,103	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
35	21 晋能电 力 MTN015	企业债务 融资工具	102103210. IB	37,574	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
36	21 江门高 新 MTN001	企业债务 融资工具	102103204. IB	10,735	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
37	21 高淳经 开 PPN002	企业债务 融资工具	032191360. IB	13,419	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
38	22 中国银 行永续债 02	商业性金 融债券	2228029. IB	236,181	100.5922	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
39	21 农业银 行永续债 01	商业性金 融债券	2128038. IB	72,464	100.5399	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商

40	22 宿迁水务 MTN002	企业债务融资工具	102281374. IB	2,683	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
41	21 兴业银行二级 03	商业性金融债券	2128043. IB	25,632	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
42	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	51,265	102.1997	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
43	20 中建四局 MTN002	企业债务融资工具	102002093. IB	8,544	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
44	21 建设银行二级 05	商业性金融债券	2128049. IB	8,544	100.3469	中国建设银行股份有限公司	债务主体
45	21 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	25,632	101.4388	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
46	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	68,354	99.0085	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
47	21 建设银行二级 01	商业性金融债券	2128025. IB	12,816	99.7281	中国建设银行股份有限公司	债务主体
48	21 川能投 MTN002B	企业债务融资工具	102101521. IB	25,632	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
49	20 昊华(疫情防控债) MTN001	企业债务融资工具	102000760. IB	4,272	97.9596	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	20 中建四局 MTN001	企业债务融资工具	102001942. IB	4,272	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	21 兴业银行二级 02	商业性金融债券	2128042. IB	21,360	100.7699	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
52	22 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2228003. IB	21,360	99.8249	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	21 建设银行二级 03	商业性金融债券	2128033. IB	93,986	100.5610	中国建设银行股份有限公司	债务主体
54	22 鲁宏桥 CP002	企业债务融资工具	042280376. IB	12,816	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

(二) 理财产品投资关联方发行的资产管理产品

无

（三）其他关联交易

无

九、投资非标准化债权及股权类资产清单（见附录一）

十、产品整体运作情况

本产品自成立至本报告日，产品管理人恪尽职守、勤勉尽责、谨慎管理。

特此公告

建信理财有限责任公司

2023 年 03 月 31 日

附录一

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）投资非标准化
债权及股权类资产清单

报告日：2023 年 03 月 31 日

我司依照监管要求，现对建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）投资非标准化债权及股权类资产清单披露如下：

交易结构	融资客户名称	项目名称	剩余融资期限（天）	风险状况
非标准化债权类资产	深圳前海华宝供应链有限公司	22 前海华宝 AB017	549	正常

除上述资产外，产品投资其他资产的风险状况：正常
到期收益分配详见产品说明书。